

中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 3 月 14 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	中金中证 1000 指数增强发起	
基金主代码	017733	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 14 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	124,936,202.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	017733	017734
报告期末下属分级基金的份额总额	85,406,279.70 份	39,529,923.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金主要的股票投资策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。详见《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的业绩表现。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险。本基金

	可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰	陆志俊
	联系电话	010-63211122	95559
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-868-1166	95559
传真		010-66159121	021-62701216
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 188 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100004	200336
法定代表人		胡长生	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
和指标	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 C
本期已实现收益	-205,088.16	635,282.07
本期利润	-75,016.56	525,559.33
加权平均基金份 额本期利润	-0.0007	0.0089
本期加权平均净 值利润率	-0.08%	0.89%

本期基金份额净值增长率	-0.24%	-0.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-622,629.89	-335,506.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0073	-0.0085
期末基金资产净值	85,198,502.55	39,385,748.90
期末基金份额净值	0.9976	0.9964
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.24%	-0.36%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

4、本基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金中证 1000 指数增强发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.21%	0.90%	0.59%	0.99%	1.62%	-0.09%
过去三个月	-1.94%	0.83%	-3.77%	0.87%	1.83%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-0.24%	0.78%	-3.19%	0.85%	2.95%	-0.07%

中金中证 1000 指数增强发起 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

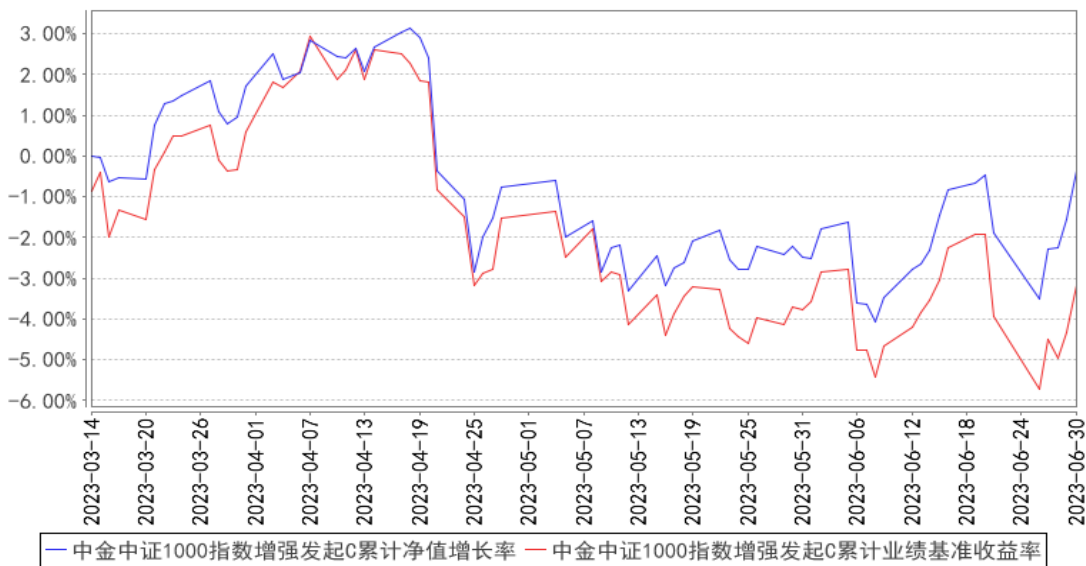
	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	2.17%	0.90%	0.59%	0.99%	1.58%	-0.09%
过去三个月	-2.04%	0.82%	-3.77%	0.87%	1.73%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-0.36%	0.78%	-3.19%	0.85%	2.83%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中金中证1000指数增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金中证1000指数增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2023 年 03 月 14 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 45 只公募基金，证券投资基金管理规模 1208.29 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
耿帅军	本基金基金经理	2023 年 3 月 14 日	-	12 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王阳峰	本基金基金经理	2023 年 3 月 14 日	-	9 年	王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部投资经理、嘉实基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

2、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安

全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于深入的研究和完备的风控流程进行组合管理，在严格控制组合偏离度的基础上，利用量化选股策略精选个股，在控制组合跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同和法律法规的前提下管理组合，争取在超额收益方面有更好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证 1000 指数增强发起 A 基金份额净值为 0.9976 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.24%，同期业绩基准收益率为-3.19%；中金中证 1000 指数增强发起 C 基金份额净值为 0.9964 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.36%，同期业绩基准收益率为-3.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济持续恢复，总体回升向好，政策精准发力，宏观流动性充裕。回顾 A 股市场整体表现，主要规模指数表现分化，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，中证 1000 上涨 5.10%，创业板指下跌 5.61%，科创 50 上涨 4.71%。从经济运行客观规律来分析，疫情防控平稳转段后，经济复苏并不是一个简单线性、一蹴而就的过程，不过，从上半年资本市场的表现看，市场一致预期往往容易阶段性低估这一过程的曲折性，这或可部分解释市场整体节奏变化和风格表现变迁。

展望下半年，尽管国内经济增长仍面临各种复杂因素的挑战，但在经济内在动能边际增强和政策组合拳全方位支持下，经济复苏与高质量发展将继续成为下半年国内经济的主题。A 股市场整体估值处于历史相对低位水平，对各类不确定性因素定价已较为充分，伴随上市公司业绩重回增长趋势，市场中期机会大于风险。考虑到疫情等非典型因素对上市公司盈利带来的扰动已不断淡化，市场有望从主题投资的热潮逐步转向对公司基本面的重视。

我们将坚持“高质研究驱动高效投资”的理念，不断挖掘具备长期配置价值的策略，并相对均衡地配置各类型策略，力争获取可持续的长期收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中金基金管理有限公司在中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金投资运

作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中金基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	7,705,105.08
结算备付金		848,413.73
存出保证金		156,873.60
交易性金融资产	6.4.7.2	116,010,336.08
其中：股票投资		116,010,336.08
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		93,129.90
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		124,813,858.39

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		55,996.45
应付管理人报酬		82,509.91
应付托管费		15,470.61
应付销售服务费		12,990.68
应付投资顾问费		-
应交税费		126.57
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	62,512.72
负债合计		229,606.94
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	124,936,202.87
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-351,951.42
净资产合计		124,584,251.45
负债和净资产总计		124,813,858.39

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，中金中证 1000 指数增强发起 A 的基金份额净值为 0.9976 元，期末份额总额为 85,406,279.70 份；中金中证 1000 指数增强发起 C 的基金份额净值为 0.9964 元，期末份额总额为 39,529,923.17 份。基金份额总额 124,936,202.87 份。

2、本基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，本报告期自 2023 年 3 月 14 日至 2023 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 3 月 14 日（基金合同 生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,020,035.56
1. 利息收入		30,967.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,967.79
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		968,717.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-404,544.90
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	3,787.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-31.06
股利收益	6.4.7.19	1,369,505.44
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	20,348.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1.46
减：二、营业总支出		569,492.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	371,824.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,717.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	68,429.06
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	59,522.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		450,542.77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		450,542.77
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		450,542.77

注：本基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	203,460,403.33	-	-	203,460,403.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-78,524,200.46	-	-351,951.42	-78,876,151.88
(一)、综合收益总额	-	-	450,542.77	450,542.77
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-78,524,200.46	-	-802,494.19	-79,326,694.65
其中：1. 基金申购款	2,554,370.08	-	-47,342.84	2,507,027.24
2. 基金赎回款	-81,078,570.54	-	-755,151.35	-81,833,721.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	124,936,202.87	-	-351,951.42	124,584,251.45

注：本基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵璧

二

白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2022 年 12 月 16 日证监许可 [2022] 3195 号文《关于准予中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国中金财富证券有限公司、申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司等共同销售，募集期为 2023 年 2 月 27 日起至 2023 年 3 月 10 日。经向中国证监会备案，《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2023 年 3 月 14 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,460,403.33 份（含利息转份额 51,321.57 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购时收取认/申购费用，赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式为计算日某类基金份额净值=该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监

会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况、自 2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为自 2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

-本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

-该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或

金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

以摊余成本计量的金融资产：初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债：初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流

量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(a) 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认利息收入。

(b) 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

(c) 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018

年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,705,105.08
等于：本金	7,703,696.71
加：应计利息	1,408.37
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,705,105.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	115,993,740.65	-	116,010,336.08	16,595.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	115,993,740.65	-	116,010,336.08	16,595.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,303,400.00	-	-	-
其中：股	1,303,400.00	-	-	-

股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,303,400.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2309	IM2309	1.00	1,307,280.00	3,880.00
合计				3,880.00
减：可抵销期货暂收款				3,880.00
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,522.72
其他	2,990.00
合计	62,512.72

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金中证 1000 指数增强发起 A

项目	本期 2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	115,561,785.72	115,561,785.72
本期申购	1,015,022.70	1,015,022.70
本期赎回（以“-”号填列）	-31,170,528.72	-31,170,528.72
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	85,406,279.70	85,406,279.70

中金中证 1000 指数增强发起 C

项目	本期
----	----

	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	87,898,617.61	87,898,617.61
本期申购	1,539,347.38	1,539,347.38
本期赎回（以“-”号填列）	-49,908,041.82	-49,908,041.82
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	39,529,923.17	39,529,923.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金中证 1000 指数增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-205,088.16	130,071.60	-75,016.56
本期基金份额交易产生的变动数	-417,541.73	284,781.14	-132,760.59
其中：基金申购款	-5,616.95	-8,551.89	-14,168.84
基金赎回款	-411,924.78	293,333.03	-118,591.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-622,629.89	414,852.74	-207,777.15

中金中证 1000 指数增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	635,282.07	-109,722.74	525,559.33
本期基金份额交易产生的变动数	-970,788.35	301,054.75	-669,733.60
其中：基金申购款	-4,903.12	-28,270.88	-33,174.00
基金赎回款	-965,885.23	329,325.63	-636,559.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-335,506.28	191,332.01	-144,174.27

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,529.40

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,438.39
其他	-
合计	30,967.79

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-404,544.90
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-404,544.90

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	429,930,199.68
减：卖出股票成本总额	429,243,277.05
减：交易费用	1,091,467.53
买卖股票差价收入	-404,544.90

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,785.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,787.97

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月14日（基金合同生效日）至2023年6月 30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,588.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,800.00
减：应计利息总额	2.10
减：交易费用	0.83
买卖债券差价收入	3,785.87

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-31.06

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,369,505.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,369,505.44

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	16,595.43
股票投资	16,595.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	3,866.44
权证投资	-
期货投资	3,866.44
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	113.01
合计	20,348.86

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	1.46
合计	1.46

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,880.68
信息披露费	44,642.04
证券出借违约金	-
合计	59,522.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
交通银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东
中国中金财富证券有限公司（以下简称“中金财富证券”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	371,824.01
其中：支付销售机构的客户维护费	167,994.78

注：1、支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数；
2、本基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,717.00

注：1、支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数；
2、本基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 C	合计
中金基金	-	5,872.13	5,872.13

交通银行	-	43,648.77	43,648.77
中金财富证券	-	671.56	671.56
合计	-	50,192.46	50,192.46

- 注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费；
- 2、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。
- 3、本基金基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）持有的基金份额	5,000,900.00	5,000,900.00
报告期初持有的基金份额	5,000,900.00	5,000,900.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,900.00	5,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.8554%	12.6509%

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	6,824,909.82	24,156.59

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中金公司	688593	新相微	网下	2,934	32,802.12
中金公司	688472	阿特斯	网下	4,451	49,406.10
中金公司	688334	西高院	网下	2,430	34,408.80

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	96	6,458.88	6,281.28	-
301323	新莱福	2023 年 5 月	6 个月	新股流通	39.06	39.36	69	2,695.14	2,715.84	-

		29 日		受限						
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	243	3,440.88	3,939.03	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	124	2,380.80	3,165.72	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	446	4,950.60	7,599.84	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	179	3,912.94	4,269.15	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	86	3,755.62	4,562.30	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	127	3,843.02	3,216.91	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	40	5,432.00	4,816.40	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	294	3,286.92	4,289.46	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	330	3,524.40	4,072.20	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	32	4,028.16	2,777.28	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	298	2,759.48	5,539.82	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	96	2,426.88	2,867.52	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型指数增强基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。对于上述风险本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,703,696.71	-	-	1,408.37	7,705,105.08
结算备付金	848,134.65	-	-	279.08	848,413.73
存出保证金	-	-	-	156,873.60	156,873.60
交易性金融资产	-	-	-	116,010,336.08	116,010,336.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	93,129.90	93,129.90
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,551,831.36	-	-	116,262,027.03	124,813,858.39
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	55,996.45	55,996.45
应付销售服务费	-	-	-	12,990.68	12,990.68
应付管理人报酬	-	-	-	82,509.91	82,509.91
应付托管费	-	-	-	15,470.61	15,470.61
应交税费	-	-	-	126.57	126.57
其他负债	-	-	-	62,512.72	62,512.72
负债总计	-	-	-	229,606.94	229,606.94
利率敏感度缺口	8,551,831.36	-	-	-116,032,420.09	124,584,251.45

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券、可交换债券）和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	116,010,336.08	93.12
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	116,010,336.08	93.12

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	115,950,223.33
第二层次	-
第三层次	60,112.75
合计	116,010,336.08

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	116,010,336.08	92.95
	其中：股票	116,010,336.08	92.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,553,518.81	6.85
8	其他各项资产	250,003.50	0.20
9	合计	124,813,858.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	43,704.00	0.04
B	采矿业	1,778,634.00	1.43
C	制造业	81,911,343.65	65.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,957,663.00	2.37
E	建筑业	2,338,752.00	1.88
F	批发和零售业	3,267,680.00	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	2,017,836.00	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,054,457.02	8.87
J	金融业	2,274,038.80	1.83
K	房地产业	2,143,538.96	1.72
L	租赁和商务服务业	590,188.90	0.47
M	科学研究和技术服务业	1,741,455.00	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	1,146,840.00	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	205,968.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	1,979,158.00	1.59
S	综合	-	-
	合计	115,451,257.33	92.67

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	54,635.00	0.04
C	制造业	497,637.20	0.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,867.52	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,939.03	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	559,078.75	0.45

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002402	和而泰	67,200	1,141,056.00	0.92
2	600612	老凤祥	16,000	1,118,080.00	0.90
3	601908	京运通	183,500	1,110,175.00	0.89
4	603279	景津装备	34,400	1,078,784.00	0.87
5	002472	双环传动	28,700	1,041,810.00	0.84
6	002737	葵花药业	42,300	1,029,582.00	0.83

7	002367	康力电梯	112,300	1,025,299.00	0.82
8	600456	宝钛股份	29,700	1,005,048.00	0.81
9	601567	三星医疗	76,400	964,932.00	0.77
10	603027	千禾味业	45,100	952,512.00	0.76
11	002929	润建股份	21,300	924,633.00	0.74
12	002573	清新环境	164,400	905,844.00	0.73
13	002139	拓邦股份	67,000	874,350.00	0.70
14	002484	江海股份	40,500	862,245.00	0.69
15	002839	张家港行	199,900	845,577.00	0.68
16	002545	东方铁塔	119,742	845,378.52	0.68
17	600328	中盐化工	93,590	842,310.00	0.68
18	002706	良信股份	74,200	834,750.00	0.67
19	600888	新疆众和	105,000	831,600.00	0.67
20	603368	柳药集团	33,600	830,256.00	0.67
21	002171	楚江新材	116,300	828,056.00	0.66
22	002434	万里扬	91,200	816,240.00	0.66
23	300777	中简科技	17,100	808,146.00	0.65
24	000921	海信家电	29,100	784,245.00	0.63
25	688711	宏微科技	13,340	778,255.60	0.62
26	688556	高测股份	14,211	755,172.54	0.61
27	603916	苏博特	57,000	754,680.00	0.61
28	688318	财富趋势	7,478	747,575.66	0.60
29	000811	冰轮环境	47,100	742,296.00	0.60
30	301050	雷电微力	10,860	705,139.80	0.57
31	002060	粤水电	103,100	678,398.00	0.54
32	001696	宗申动力	95,500	676,140.00	0.54
33	600750	江中药业	30,800	675,444.00	0.54
34	002498	汉缆股份	164,500	659,645.00	0.53
35	002990	盛视科技	17,900	658,720.00	0.53
36	688050	爱博医疗	3,154	647,610.82	0.52
37	600098	广州发展	103,500	639,630.00	0.51
38	600206	有研新材	48,100	632,034.00	0.51
39	300775	三角防务	18,600	628,308.00	0.50
40	600216	浙江医药	57,200	626,340.00	0.50
41	603197	保隆科技	11,400	618,450.00	0.50
42	002847	盐津铺子	7,150	608,107.50	0.49
43	600572	康恩贝	88,100	603,485.00	0.48
44	300263	隆华科技	72,400	602,368.00	0.48
45	600308	华泰股份	159,920	594,902.40	0.48
46	300332	天壕环境	51,700	592,999.00	0.48
47	300443	金雷股份	16,400	581,380.00	0.47
48	002727	一心堂	21,900	578,160.00	0.46
49	600929	雪天盐业	71,500	567,710.00	0.46

50	601137	博威合金	36,100	561,716.00	0.45
51	002967	广电计量	27,900	560,511.00	0.45
52	688131	皓元医药	9,800	558,404.00	0.45
53	300109	新开源	22,300	554,601.00	0.45
54	605123	派克新材	5,100	554,115.00	0.44
55	605507	国邦医药	26,000	553,020.00	0.44
56	600284	浦东建设	90,200	552,024.00	0.44
57	000650	仁和药业	88,600	544,004.00	0.44
58	601975	招商南油	189,500	541,970.00	0.44
59	603328	依顿电子	65,200	539,856.00	0.43
60	002421	达实智能	152,700	537,504.00	0.43
61	002895	川恒股份	27,200	535,840.00	0.43
62	605168	三人行	6,235	535,835.90	0.43
63	300133	华策影视	74,100	525,369.00	0.42
64	300634	彩讯股份	19,800	522,720.00	0.42
65	600639	浦东金桥	42,000	521,220.00	0.42
66	000951	中国重汽	30,700	517,295.00	0.42
67	600583	海油工程	88,000	514,800.00	0.41
68	000030	富奥股份	101,800	513,072.00	0.41
69	688106	金宏气体	18,800	511,360.00	0.41
70	002100	天康生物	61,700	509,025.00	0.41
71	688100	威胜信息	17,031	507,694.11	0.41
72	688733	壹石通	16,267	503,626.32	0.40
73	600400	红豆股份	151,900	498,232.00	0.40
74	600618	氯碱化工	55,500	497,835.00	0.40
75	002424	贵州百灵	54,900	493,002.00	0.40
76	002782	可立克	32,100	490,809.00	0.39
77	600064	南京高科	73,700	487,157.00	0.39
78	002048	宁波华翔	36,300	486,420.00	0.39
79	002283	天润工业	75,500	484,710.00	0.39
80	600850	电科数字	20,528	484,255.52	0.39
81	000552	甘肃能化	144,900	482,517.00	0.39
82	601918	新集能源	113,300	481,525.00	0.39
83	600531	豫光金铅	76,000	478,800.00	0.38
84	002106	莱宝高科	56,100	476,850.00	0.38
85	603299	苏盐井神	47,700	476,046.00	0.38
86	002335	科华数据	13,200	474,540.00	0.38
87	000828	东莞控股	51,400	470,310.00	0.38
88	601126	四方股份	30,500	463,295.00	0.37
89	603387	基蛋生物	35,900	462,751.00	0.37
90	688798	艾为电子	7,800	461,370.00	0.37
91	002063	远光软件	52,600	456,568.00	0.37
92	601369	陕鼓动力	50,000	455,500.00	0.37

93	000034	神州数码	17,000	452,030.00	0.36
94	600596	新安股份	41,200	450,316.00	0.36
95	003040	楚天龙	24,800	449,872.00	0.36
96	601019	山东出版	47,400	434,658.00	0.35
97	600742	一汽富维	52,600	430,794.00	0.35
98	603766	隆鑫通用	81,300	429,264.00	0.34
99	600211	西藏药业	7,200	427,680.00	0.34
100	000875	吉电股份	78,900	425,271.00	0.34
101	601222	林洋能源	51,800	424,242.00	0.34
102	002987	京北方	19,300	423,056.00	0.34
103	600562	国睿科技	26,100	422,820.00	0.34
104	601929	吉视传媒	229,600	422,464.00	0.34
105	603053	成都燃气	41,300	415,891.00	0.33
106	600577	精达股份	98,500	415,670.00	0.33
107	603466	风语筑	29,800	414,220.00	0.33
108	600649	城投控股	105,100	413,043.00	0.33
109	300463	迈克生物	27,300	412,776.00	0.33
110	002004	华邦健康	82,500	412,500.00	0.33
111	600635	大众公用	123,700	410,684.00	0.33
112	002701	奥瑞金	90,600	408,606.00	0.33
113	002467	二六三	81,300	404,061.00	0.32
114	300170	汉得信息	35,000	403,900.00	0.32
115	603989	艾华集团	19,100	402,246.00	0.32
116	002158	汉钟精机	15,800	394,368.00	0.32
117	002242	九阳股份	26,300	393,185.00	0.32
118	002416	爱施德	52,400	386,712.00	0.31
119	002258	利尔化学	29,900	386,009.00	0.31
120	300224	正海磁材	29,900	384,514.00	0.31
121	688128	中国电研	15,000	382,500.00	0.31
122	300623	捷捷微电	21,100	382,332.00	0.31
123	300315	掌趣科技	47,100	367,380.00	0.29
124	603345	安井食品	2,500	367,000.00	0.29
125	603733	仙鹤股份	17,600	366,960.00	0.29
126	300773	拉卡拉	21,000	366,240.00	0.29
127	000059	华锦股份	57,400	361,046.00	0.29
128	603871	嘉友国际	22,940	360,387.40	0.29
129	301219	腾远钴业	9,630	359,776.80	0.29
130	002020	京新药业	26,400	338,448.00	0.27
131	600477	杭萧钢构	82,100	335,789.00	0.27
132	600761	安徽合力	16,800	334,824.00	0.27
133	601886	江河集团	37,600	334,264.00	0.27
134	000718	苏宁环球	120,300	328,419.00	0.26
135	301031	中熔电气	2,400	325,704.00	0.26

136	603983	丸美股份	9,800	317,030.00	0.25
137	603235	天新药业	10,100	316,736.00	0.25
138	600273	嘉化能源	32,900	309,918.00	0.25
139	000789	万年青	39,200	303,800.00	0.24
140	000049	德赛电池	8,600	303,408.00	0.24
141	688337	普源精电	5,000	301,300.00	0.24
142	600073	上海梅林	40,900	298,570.00	0.24
143	688315	诺禾致源	11,200	297,360.00	0.24
144	600422	昆药集团	14,300	296,296.00	0.24
145	000902	新洋丰	28,600	294,008.00	0.24
146	603298	杭叉集团	12,400	292,020.00	0.23
147	603071	物产环能	17,400	288,666.00	0.23
148	688330	宏力达	8,139	285,516.12	0.23
149	300031	宝通科技	11,500	284,280.00	0.23
150	300377	赢时胜	34,100	276,210.00	0.22
151	002815	崇达技术	22,000	273,900.00	0.22
152	603323	苏农银行	65,000	273,650.00	0.22
153	002204	大连重工	52,400	269,336.00	0.22
154	002558	巨人网络	15,000	268,950.00	0.22
155	000550	江铃汽车	19,400	268,496.00	0.22
156	300294	博雅生物	7,300	264,844.00	0.21
157	300232	洲明科技	28,800	263,232.00	0.21
158	688278	特宝生物	5,986	262,845.26	0.21
159	600197	伊力特	9,400	255,398.00	0.21
160	002597	金禾实业	10,800	254,880.00	0.20
161	603093	南华期货	23,400	254,826.00	0.20
162	603301	振德医疗	8,500	251,770.00	0.20
163	002456	欧菲光	44,600	249,760.00	0.20
164	300130	新国都	8,600	243,638.00	0.20
165	600977	中国电影	17,200	241,660.00	0.19
166	600458	时代新材	20,000	239,800.00	0.19
167	603171	税友股份	5,900	235,882.00	0.19
168	002851	麦格米特	6,400	233,408.00	0.19
169	603118	共进股份	17,360	230,714.40	0.19
170	601952	苏垦农发	19,500	226,980.00	0.18
171	603129	春风动力	1,400	226,660.00	0.18
172	600285	羚锐制药	14,000	224,840.00	0.18
173	002312	川发龙蟒	26,900	218,697.00	0.18
174	000627	天茂集团	72,400	217,200.00	0.17
175	300693	盛弘股份	5,800	214,136.00	0.17
176	688266	泽璟制药	4,600	214,130.00	0.17
177	601801	皖新传媒	22,800	214,092.00	0.17
178	603208	江山欧派	5,790	210,871.80	0.17

179	600662	外服控股	36,500	208,780.00	0.17
180	002215	诺普信	27,700	208,027.00	0.17
181	002865	钧达股份	1,358	207,135.74	0.17
182	300723	一品红	7,050	206,565.00	0.17
183	301239	普瑞眼科	2,100	205,968.00	0.17
184	002698	博实股份	11,700	204,633.00	0.16
185	300206	理邦仪器	13,300	200,564.00	0.16
186	300034	钢研高纳	5,000	196,950.00	0.16
187	600007	中国国贸	10,598	196,274.96	0.16
188	000048	京基智农	10,000	195,200.00	0.16
189	002332	仙琚制药	14,700	194,775.00	0.16
190	600389	江山股份	8,125	192,968.75	0.15
191	600557	康缘药业	7,000	192,220.00	0.15
192	000928	中钢国际	19,700	190,105.00	0.15
193	601519	大智慧	26,400	189,024.00	0.15
194	688298	东方生物	4,988	188,147.36	0.15
195	688586	江航装备	13,484	187,562.44	0.15
196	300114	中航电测	3,800	186,770.00	0.15
197	300457	赢合科技	10,500	185,430.00	0.15
198	600295	鄂尔多斯	20,420	183,167.40	0.15
199	603100	川仪股份	4,700	182,642.00	0.15
200	600869	远东股份	33,000	182,160.00	0.15
201	688018	乐鑫科技	1,400	181,748.00	0.15
202	600480	凌云股份	22,800	179,208.00	0.14
203	300203	聚光科技	8,800	178,376.00	0.14
204	603881	数据港	7,800	176,202.00	0.14
205	688707	振华新材	5,676	174,764.04	0.14
206	600502	安徽建工	32,500	171,600.00	0.14
207	002206	海利得	32,000	171,520.00	0.14
208	002324	普利特	12,000	171,240.00	0.14
209	300358	楚天科技	11,400	170,202.00	0.14
210	002017	东信和平	12,930	169,512.30	0.14
211	603919	金徽酒	7,100	166,708.00	0.13
212	603179	新泉股份	3,798	166,694.22	0.13
213	002583	海能达	28,600	166,166.00	0.13
214	688235	百济神州	1,487	162,246.57	0.13
215	300036	超图软件	6,800	161,228.00	0.13
216	688660	电气风电	28,783	160,321.31	0.13
217	300666	江丰电子	2,300	156,308.00	0.13
218	002517	恺英网络	9,900	155,826.00	0.13
219	600586	金晶科技	20,000	154,400.00	0.12
220	301047	义翘神州	1,800	154,260.00	0.12
221	002605	姚记科技	3,300	153,219.00	0.12

222	002174	游族网络	9,000	151,200.00	0.12
223	601311	骆驼股份	16,100	149,408.00	0.12
224	300303	聚飞光电	23,800	148,988.00	0.12
225	002918	蒙娜丽莎	9,600	148,224.00	0.12
226	002276	万马股份	12,200	147,742.00	0.12
227	603113	金能科技	18,100	146,429.00	0.12
228	000989	九芝堂	10,400	143,936.00	0.12
229	002612	朗姿股份	6,000	142,680.00	0.11
230	600223	福瑞达	13,900	142,614.00	0.11
231	688499	利元亨	2,240	142,284.80	0.11
232	600710	苏美达	16,600	142,096.00	0.11
233	600966	博汇纸业	23,978	141,949.76	0.11
234	603566	普莱柯	6,100	141,825.00	0.11
235	300638	广和通	6,200	140,616.00	0.11
236	600496	精工钢构	37,200	138,756.00	0.11
237	002217	合力泰	39,100	138,023.00	0.11
238	600996	贵广网络	13,800	135,516.00	0.11
239	600569	安阳钢铁	68,000	135,320.00	0.11
240	002261	拓维信息	7,000	135,170.00	0.11
241	605009	豪悦护理	2,800	134,400.00	0.11
242	603229	奥翔药业	6,400	134,272.00	0.11
243	000756	新华制药	6,200	133,796.00	0.11
244	000923	河钢资源	9,900	133,650.00	0.11
245	600835	上海机电	7,700	132,286.00	0.11
246	688166	博瑞医药	6,000	131,940.00	0.11
247	002950	奥美医疗	12,600	130,788.00	0.10
248	002991	甘源食品	1,700	130,390.00	0.10
249	603719	良品铺子	5,100	127,551.00	0.10
250	688083	中望软件	880	127,503.20	0.10
251	301035	润丰股份	1,600	125,712.00	0.10
252	300502	新易盛	1,840	125,064.80	0.10
253	600129	太极集团	2,100	124,929.00	0.10
254	600125	铁龙物流	20,500	123,820.00	0.10
255	600320	振华重工	33,100	123,463.00	0.10
256	002034	旺能环境	7,700	121,737.00	0.10
257	601965	中国汽研	5,800	119,770.00	0.10
258	600323	瀚蓝环境	6,300	119,259.00	0.10
259	603567	珍宝岛	7,500	112,200.00	0.09
260	603920	世运电路	5,700	111,321.00	0.09
261	688173	希荻微	4,800	109,824.00	0.09
262	002135	东南网架	17,000	109,820.00	0.09
263	002911	佛燃能源	8,500	109,310.00	0.09
264	601099	太平洋	42,200	108,876.00	0.09

265	603505	金石资源	4,640	108,344.00	0.09
266	603599	广信股份	4,000	108,320.00	0.09
267	600100	同方股份	13,300	107,996.00	0.09
268	002832	比音勒芬	3,000	106,230.00	0.09
269	300339	润和软件	4,400	105,424.00	0.08
270	300593	新雷能	4,600	105,386.00	0.08
271	600267	海正药业	9,200	104,696.00	0.08
272	600363	联创光电	2,800	103,880.00	0.08
273	688518	联赢激光	3,694	102,914.84	0.08
274	002610	爱康科技	40,000	102,400.00	0.08
275	002262	恩华药业	3,300	101,739.00	0.08
276	002055	得润电子	10,600	101,336.00	0.08
277	300747	锐科激光	3,300	100,584.00	0.08
278	300672	国科微	1,200	100,020.00	0.08
279	600312	平高电气	8,000	99,120.00	0.08
280	600587	新华医疗	2,800	98,924.00	0.08
281	600391	航发科技	4,100	98,851.00	0.08
282	601890	亚星锚链	8,500	98,430.00	0.08
283	000761	本钢板材	24,600	98,400.00	0.08
284	000539	粤电力 A	13,400	97,820.00	0.08
285	000422	湖北宜化	8,500	97,580.00	0.08
286	002906	华阳集团	2,800	95,732.00	0.08
287	000915	华特达因	2,700	95,283.00	0.08
288	000727	冠捷科技	44,700	94,764.00	0.08
289	603906	龙蟠科技	5,200	94,380.00	0.08
290	002212	天融信	9,700	94,090.00	0.08
291	300674	宇信科技	5,300	93,704.00	0.08
292	300910	瑞丰新材	1,851	93,105.30	0.07
293	000913	钱江摩托	5,100	92,973.00	0.07
294	002318	久立特材	5,400	91,962.00	0.07
295	300772	运达股份	7,100	91,448.00	0.07
296	600729	重庆百货	2,900	91,176.00	0.07
297	000555	神州信息	7,400	91,020.00	0.07
298	603103	横店影视	5,400	90,936.00	0.07
299	000528	柳 工	11,500	90,850.00	0.07
300	002051	中工国际	7,600	90,668.00	0.07
301	300428	立中集团	3,900	89,934.00	0.07
302	002768	国恩股份	3,700	89,503.00	0.07
303	000686	东北证券	12,700	88,138.00	0.07
304	600993	马应龙	3,164	87,990.84	0.07
305	600169	太原重工	35,400	87,792.00	0.07
306	002038	双鹭药业	8,700	87,783.00	0.07
307	002440	闰土股份	13,100	87,377.00	0.07

308	600789	鲁抗医药	13,600	87,312.00	0.07
309	002015	协鑫能科	6,500	87,295.00	0.07
310	300236	上海新阳	2,200	87,230.00	0.07
311	603997	继峰股份	6,100	87,230.00	0.07
312	300119	瑞普生物	4,900	87,220.00	0.07
313	300633	开立医疗	1,600	87,200.00	0.07
314	002237	恒邦股份	8,000	87,120.00	0.07
315	688326	经纬恒润	600	86,634.00	0.07
316	300166	东方国信	7,700	86,548.00	0.07
317	688232	新点软件	1,600	86,096.00	0.07
318	301236	软通动力	3,150	85,711.50	0.07
319	688088	虹软科技	2,000	85,500.00	0.07
320	688425	铁建重工	17,600	84,656.00	0.07
321	002085	万丰奥威	12,200	84,546.00	0.07
322	600335	国机汽车	7,400	84,360.00	0.07
323	300171	东富龙	3,700	84,175.00	0.07
324	002639	雪人股份	10,100	84,133.00	0.07
325	600120	浙江东方	21,900	83,877.00	0.07
326	600841	动力新科	13,700	83,570.00	0.07
327	002302	西部建设	11,700	83,538.00	0.07
328	002036	联创电子	8,600	83,506.00	0.07
329	603877	太平鸟	3,300	83,424.00	0.07
330	002233	塔牌集团	10,800	83,376.00	0.07
331	688508	芯朋微	1,436	83,273.64	0.07
332	601609	金田股份	12,700	82,423.00	0.07
333	300459	汤姆猫	12,500	81,125.00	0.07
334	002489	浙江永强	20,000	81,000.00	0.07
335	601515	东风股份	18,400	80,592.00	0.06
336	000016	深康佳 A	17,000	80,240.00	0.06
337	002243	力合科创	9,400	79,994.00	0.06
338	600811	东方集团	35,600	79,744.00	0.06
339	600248	陕建股份	16,700	79,659.00	0.06
340	688016	心脉医疗	433	77,888.04	0.06
341	002151	北斗星通	2,200	77,352.00	0.06
342	002641	公元股份	13,600	76,704.00	0.06
343	002405	四维图新	6,600	76,428.00	0.06
344	603530	神马电力	4,900	76,195.00	0.06
345	688019	安集科技	460	75,821.80	0.06
346	002126	银轮股份	4,163	73,685.10	0.06
347	601068	中铝国际	13,600	72,896.00	0.06
348	300702	天宇股份	3,000	72,810.00	0.06
349	688608	恒玄科技	600	72,618.00	0.06
350	000885	城发环境	5,400	71,874.00	0.06

351	000498	山东路桥	11,100	71,262.00	0.06
352	002068	黑猫股份	5,900	70,033.00	0.06
353	600997	开滦股份	11,300	67,461.00	0.05
354	688366	昊海生科	800	67,376.00	0.05
355	688037	芯源微	394	67,354.30	0.05
356	688331	荣昌生物	1,200	66,900.00	0.05
357	300393	中来股份	4,700	65,988.00	0.05
358	000917	电广传媒	9,000	65,790.00	0.05
359	000600	建投能源	8,500	65,705.00	0.05
360	002697	红旗连锁	11,200	65,408.00	0.05
361	601677	明泰铝业	4,700	65,236.00	0.05
362	002061	浙江交科	14,600	65,116.00	0.05
363	603489	八方股份	920	64,510.40	0.05
364	002389	航天彩虹	2,900	64,409.00	0.05
365	603032	德新科技	1,840	63,553.60	0.05
366	300762	上海瀚讯	5,300	62,381.00	0.05
367	603236	移远通信	1,080	62,326.80	0.05
368	600688	上海石化	19,900	61,889.00	0.05
369	002320	海峡股份	10,200	61,608.00	0.05
370	002194	武汉凡谷	5,600	61,208.00	0.05
371	600446	金证股份	4,200	61,068.00	0.05
372	002396	星网锐捷	2,700	60,993.00	0.05
373	600017	日照港	20,300	60,697.00	0.05
374	603565	中谷物流	5,572	60,177.60	0.05
375	688408	中信博	707	59,621.31	0.05
376	300770	新媒股份	1,300	59,618.00	0.05
377	688739	成大生物	1,796	59,196.16	0.05
378	600490	鹏欣资源	16,000	58,880.00	0.05
379	300894	火星号	2,300	58,742.00	0.05
380	002214	大立科技	4,300	58,695.00	0.05
381	002516	旷达科技	12,100	58,564.00	0.05
382	300077	国民技术	4,400	58,520.00	0.05
383	000848	承德露露	6,600	58,410.00	0.05
384	301015	百洋医药	2,100	58,296.00	0.05
385	688559	海目星	1,240	58,292.40	0.05
386	601921	浙版传媒	6,700	58,223.00	0.05
387	600787	中储股份	10,800	58,212.00	0.05
388	600063	皖维高新	11,500	58,075.00	0.05
389	002649	博彦科技	4,100	57,933.00	0.05
390	688091	上海谊众	786	57,873.18	0.05
391	002043	兔宝宝	5,300	57,823.00	0.05
392	002267	陕天然气	7,300	57,816.00	0.05
393	002978	安宁股份	1,800	57,798.00	0.05

394	300735	光弘科技	5,400	57,780.00	0.05
395	001323	慕思股份	1,700	57,732.00	0.05
396	301177	迪阿股份	1,500	57,645.00	0.05
397	002291	遥望科技	4,400	57,640.00	0.05
398	300085	银之杰	4,900	57,624.00	0.05
399	601702	华峰铝业	4,200	57,456.00	0.05
400	300981	中红医疗	3,790	57,418.50	0.05
401	300869	康泰医学	2,500	57,400.00	0.05
402	600633	浙数文化	3,500	56,735.00	0.05
403	301200	大族数控	1,400	55,832.00	0.04
404	000966	长源电力	9,900	55,242.00	0.04
405	300856	科思股份	700	55,139.00	0.04
406	002287	奇正藏药	2,300	54,970.00	0.04
407	603013	亚普股份	3,500	54,880.00	0.04
408	000011	深物业 A	5,900	54,811.00	0.04
409	600812	华北制药	9,800	54,782.00	0.04
410	300630	普利制药	2,800	54,740.00	0.04
411	002724	海洋王	6,300	54,684.00	0.04
412	600643	爱建集团	10,900	54,500.00	0.04
413	300369	绿盟科技	4,400	54,428.00	0.04
414	002400	省广集团	11,300	54,353.00	0.04
415	002003	伟星股份	5,800	54,288.00	0.04
416	000019	深粮控股	7,300	54,166.00	0.04
417	300366	创意信息	4,200	51,912.00	0.04
418	603876	鼎胜新材	2,680	51,429.20	0.04
419	002932	明德生物	1,979	51,236.31	0.04
420	688202	美迪西	600	51,150.00	0.04
421	688368	晶丰明源	400	50,884.00	0.04
422	300204	舒泰神	5,100	50,745.00	0.04
423	002984	森麒麟	1,600	50,336.00	0.04
424	688699	明微电子	1,000	50,320.00	0.04
425	002959	小熊电器	600	50,100.00	0.04
426	603533	掌阅科技	1,800	49,896.00	0.04
427	300579	数字认证	1,700	49,130.00	0.04
428	600872	中炬高新	1,300	47,827.00	0.04
429	002436	兴森科技	3,000	46,500.00	0.04
430	002234	民和股份	2,400	43,704.00	0.04
431	600210	紫江企业	8,200	43,624.00	0.04
432	000567	海德股份	3,390	43,459.80	0.03
433	000652	泰达股份	10,300	42,436.00	0.03
434	600908	无锡银行	7,900	42,344.00	0.03
435	688321	微芯生物	1,800	40,752.00	0.03
436	002216	三全食品	2,600	40,508.00	0.03

437	603297	永新光学	500	39,950.00	0.03
438	300451	创业慧康	4,700	39,386.00	0.03
439	603308	应流股份	2,000	36,600.00	0.03
440	002643	万润股份	2,100	36,561.00	0.03
441	601528	瑞丰银行	7,500	36,375.00	0.03
442	000712	锦龙股份	2,900	36,192.00	0.03
443	600449	宁夏建材	2,300	35,788.00	0.03
444	688023	安恒信息	200	34,942.00	0.03
445	000682	东方电子	3,400	33,048.00	0.03
446	000488	晨鸣纸业	6,800	32,980.00	0.03
447	000801	四川九洲	4,500	32,850.00	0.03
448	000090	天健集团	6,500	32,760.00	0.03
449	002145	中核钛白	5,400	31,806.00	0.03
450	688139	海尔生物	600	30,882.00	0.02
451	603306	华懋科技	1,000	29,020.00	0.02
452	688399	硕世生物	515	28,428.00	0.02
453	601678	滨化股份	5,300	24,592.00	0.02
454	300627	华测导航	500	16,235.00	0.01
455	301087	可孚医疗	300	14,790.00	0.01
456	688639	华恒生物	161	14,567.28	0.01
457	000860	顺鑫农业	400	13,476.00	0.01
458	688066	航天宏图	195	11,875.50	0.01
459	300379	东方通	500	10,285.00	0.01
460	600986	浙文互联	1,500	9,600.00	0.01
461	600478	科力远	1,300	9,282.00	0.01
462	000028	国药一致	200	8,722.00	0.01
463	301171	易点天下	300	6,630.00	0.01
464	688001	华兴源创	173	6,127.66	0.00
465	688007	光峰科技	139	2,898.15	0.00
466	300229	拓尔思	100	2,597.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603688	石英股份	500	56,920.00	0.05
2	002518	科士达	1,400	56,014.00	0.04
3	002512	达华智能	13,700	54,937.00	0.04
4	300842	帝科股份	600	54,864.00	0.04
5	601958	金钼股份	4,900	54,635.00	0.04
6	600481	双良节能	3,900	54,522.00	0.04
7	002096	易普力	4,600	54,418.00	0.04
8	688599	天合光能	1,200	51,132.00	0.04
9	688390	固德威	200	33,372.00	0.03
10	688200	华峰测控	184	28,152.00	0.02

11	688472	阿特斯	446	7,599.84	0.01
12	301310	鑫宏业	96	6,281.28	0.01
13	688629	华丰科技	298	5,539.82	0.00
14	688576	西山科技	40	4,816.40	0.00
15	688543	国科军工	86	4,562.30	0.00
16	688593	新相微	294	4,289.46	0.00
17	688523	航天环宇	179	4,269.15	0.00
18	688620	安凯微	330	4,072.20	0.00
19	688334	西高院	243	3,939.03	0.00
20	688570	天玛智控	127	3,216.91	0.00
21	688429	时创能源	124	3,165.72	0.00
22	688631	莱斯信息	96	2,867.52	0.00
23	688623	双元科技	32	2,777.28	0.00
24	301323	新莱福	69	2,715.84	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002698	博实股份	3,792,584.00	3.04
2	600750	江中药业	3,200,845.50	2.57
3	002697	红旗连锁	2,908,928.00	2.33
4	600742	一汽富维	2,697,615.00	2.17
5	002737	葵花药业	2,692,808.24	2.16
6	600710	苏美达	2,572,973.00	2.07
7	600483	福能股份	2,465,621.00	1.98
8	600389	江山股份	2,449,693.00	1.97
9	603328	依顿电子	2,446,250.00	1.96
10	600284	浦东建设	2,429,868.00	1.95
11	603279	景津装备	2,411,443.00	1.94
12	002061	浙江交科	2,383,765.00	1.91
13	002545	东方铁塔	2,377,196.56	1.91
14	002597	金禾实业	2,308,924.00	1.85
15	688050	爱博医疗	2,298,365.12	1.84
16	601567	三星医疗	2,278,887.00	1.83
17	002126	银轮股份	2,265,152.77	1.82
18	688100	威胜信息	2,262,543.43	1.82
19	002158	汉钟精机	2,246,118.00	1.80
20	300777	中简科技	2,242,797.00	1.80

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	002698	博实股份	3,688,885.00	2.96
2	002697	红旗连锁	2,945,702.00	2.36
3	600710	苏美达	2,610,220.00	2.10
4	600750	江中药业	2,531,673.00	2.03
5	300502	新易盛	2,513,042.00	2.02
6	600483	福能股份	2,454,918.00	1.97
7	002061	浙江交科	2,339,797.00	1.88
8	002126	银轮股份	2,332,780.00	1.87
9	002463	沪电股份	2,233,066.60	1.79
10	605589	圣泉集团	2,230,634.00	1.79
11	600971	恒源煤电	2,223,785.00	1.78
12	603920	世运电路	2,188,935.00	1.76
13	300127	银河磁体	2,185,369.00	1.75
14	600742	一汽富维	2,139,425.00	1.72
15	688033	天宜上佳	2,104,255.66	1.69
16	600995	南网储能	2,097,826.00	1.68
17	603328	依顿电子	2,044,108.00	1.64
18	601921	浙版传媒	2,031,716.00	1.63
19	600458	时代新材	2,005,852.45	1.61
20	600389	江山股份	2,000,707.45	1.61

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	545,237,017.70
卖出股票收入（成交）总额	429,930,199.68

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	156,873.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	93,129.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	250,003.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
中金中证 1000 指数增强发起 A	1,667	51,233.52	5,020,747.57	5.88	80,385,532.13	94.12
中金中证 1000 指数增强发起 C	787	50,228.62	10,129,850.67	25.63	29,400,072.50	74.37
合计	2,454	50,911.25	15,150,598.24	12.13	109,785,604.63	87.87

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	中金中证 1000 指数增强发起 A	167,110.53	0.1957
	中金中证 1000 指数增强发起 C	10,032.70	0.0254
	合计	177,143.23	0.1418

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中金中证 1000 指数增强发起 A	0~10
	中金中证 1000 指数增强发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中金中证 1000 指数增强发起 A	0

	中金中证 1000 指数增强发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,800.00	8.01	10,001,800.00	8.01	自基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,800.00	8.01	10,001,800.00	8.01	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证 1000 指数增强发起 A	中金中证 1000 指数增强发起 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 14 日) 基金份额总额	115,561,785.72	87,898,617.61
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	1,015,022.70	1,539,347.38
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	31,170,528.72	49,908,041.82
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	85,406,279.70	39,529,923.17

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自 2023 年 1 月 18 日起担任公司总经理、董事，同日起不再担任公司副总经理；孙菁女士自 2023 年 1 月 18 日起不再担任公司总经理、董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华西证券	2	974,640,392.79	100.00	584,798.67	100.00	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华西证券	16,588.80	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023-02-20
2	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-02-20
3	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-02-20
4	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-02-20
5	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023-02-20
6	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023-02-20
7	中金基金管理有限公司关于不法分子	中国证监会规定媒介	2023-03-09

	假冒“中金基金”名义、虚构“中金基金静态战略投资项目”进行诈骗活动的风险提示		
8	中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023-03-15
9	关于中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金开放申购、赎回(转换、定期定额投资)业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-17
10	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-26
11	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-03
12	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-10

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日